# 汇丰晋信恒生A股行业龙头指数证券投资基金更新招募说明书摘要

（2015年第3号）

基金管理人:汇丰晋信基金管理有限公司
基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司

【重要提示】

汇丰晋信恒生A股行业龙头指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会2011年11月17日证监许可[2011]1833号文核准募集。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人承诺恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉地管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者根据所持有份额享受基金的收益,但同时也要承担相应的投资风险。基金投资中的风险包括:因整体政治、经济、社会等环境因素变化对证券价格产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险,某一基金的特定风险等。本基金属于股票型指数基金,属证券投资基金中的高风险、高收益品种,其长期平均风险和收益预期高于混合型基金,债券型基金和货币市场基金。投资有风险,投资人认购(申购)本基金时应认真阅读本招募说明书及基金合同。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2015年8月1日,有关财务数据和净值表现截止日为2015年6月30日。本招募说明书所载的财务数据未经审计。

## 一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称:汇丰晋信基金管理有限公司

住所:上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼17楼

办公地址:上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼17楼

法定代表人:杨小勇

设立日期:2005 年11 月16 日

批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监基金字【2005】172号

组织形式:有限责任公司

注册资本:2亿元人民币

存续期间:持续经营

联系人:周慧

联系电话:021-20376789

股权结构:山西信托股份有限公司(以下简称“山西信托”)持有51%的股权,HSBC Global Asset Management (UK) Limited(汇丰环球投资管理(英国)有限公司)持有49%的股权。

（二）主要人员情况

1. 董事会成员

杨小勇先生,董事长,硕士学历。曾任山西省委组织部正处级干部、山西省信托投资公司副总经理、山西省国信投资(集团)公司副总经理,山西光信实业有限公司副董事长,山西省国信投资(集团)公司党委书记、山西信托副董事长。现任晋商银行股份有限公司党委副书记、副行长(正职待遇)。

郭晋晋先生,董事,硕士学历。曾任山西省信托投资公司房地产开发部、投资实业总部副总经理,太原万丰房地产发展有限公司总经理,山西国际贸易中心有限公司总经理、董事长,山西信托董事长。现任山西省国信投资(集团)公司副总经理、党委委员。

柴宏杰先生,董事,本科学历。曾任长治银监分局办公室主任、党委办公室主任,晋商银行股份有限公司董事会办公室主任、大同分行行长,山西省国信投资(集团)公司董事会办公室主任兼党委办公室主任、中合盛资本管理有限公司董事、董事长。现任山西省国信投资(集团)公司投资总监兼投资管理部总经理。

Mr. Sridhar Chandrasekharan,董事。曾任汇丰银行董事总经理、结构化信贷全球市场主管、汇丰环球投资管理全球销售主管。现任汇丰环球投资管理首席执行官。

Mr. Pedro Augusto Botelho Bastos, 董事。曾任汇丰环球投资管理(巴西)行政总裁、汇丰环球投资管理(拉丁美洲)首席投资官、行政总裁。现任汇丰环球投资管理亚太行政总裁。王栋先生, 董事。中国注册会计师(CPA)和特许金融分析师(CFA)。曾任汇丰环球投资管理(英国)有限公司产品开发培训生、汇丰环球投资管理(香港)有限公司亚太企业拓展经理, 其后参与筹建汇丰晋信基金管理有限公司。公司成立至今历任财务总监、特别项目部总监、总经理助理。现任汇丰晋信基金管理有限公司总经理。

常修泽先生,独立董事。曾任南开大学经济研究所教授、副所长、国家计委经济研究所常务副所长、教授和博士研究生导师。现任国家发改委经济研究所教授和博士研究生导师。

Mr. Alan Howard SMITH, 独立董事,本科学历。曾任怡富控股有限公司董事、董事总经理和董事长、瑞士信贷第一波士顿副董事长、金威啤酒集团有限公司独立非执行董事, 现任香港癌症基金会、East Champ公司、利星行有限公司、会德丰有限公司独立董事。

2. 监事会成员基本情况:

焦杨先生,监事,硕士学历。曾任山西信托副总经理兼资金管理部经理,常务副总经理。现任山西省国信投资(集团)公司风控总监兼审计风控部总经理,山西证券股份有限公司监事会主席,山西省产权交易中心股份有限公司监事、监事会主席。

黄碧娟女士,监事,本科学历。曾任汇丰集团银团贷款经理、资本市场部高级经理、大中华地区债务发行部主管、环球银行部香港区常务总监、汇丰银行(中国)有限公司副行政总裁、汇丰银行(中国)有限公司行长兼行政总裁。现任汇丰集团总经理、香港上海汇丰银行有限公司大中华区行政总裁,同时担任汇丰中国董事会执行董事。

曹菁女士,监事,硕士学历。曾任中宏保险有限公司招聘经理、永乐中国培训部经理、汇丰晋信基金管理有限公司人事经理,现任汇丰晋信基金管理有限公司人力资源总监。

侯玉琦先生,监事,硕士学历。曾任山西信托及山西省国信投资(集团)公司担任交易员及投资经理,汇丰晋信基金管理有限公司高级研究员,现任汇丰晋信基金管理有限公司股票基金经理。

3. 总经理及其他高级管理人员基本情况:

王栋先生,总经理,硕士学历。中国注册会计师(CPA)和特许金融分析师(CFA)。曾任汇丰环球投资管理(英国)有限公司产品开发培训生、汇丰环球投资管理(香港)有限公司亚太企业拓展经理,其后参与筹建汇丰晋信基金管理有限公司。公司成立至今历任财务总监、特别项目部总监、国际业务与战略伙伴部总监、总经理助理。

闫太平先生,副总经理,本科学历。曾任匈牙利金鸥国际贸易公司董事、山西信托副处长、国际金融部经理。

李毅先生,副总经理,硕士学历。曾任中国国际期货经纪有限公司客户经理、中国证券监督管理委员会副处长。

王立荣先生,副总经理,硕士学历。曾任山西信托固定收益部副总经理、证券投资部副总经理、创新业务部总监;上海万方投资管理有限公司副总经理;汇丰晋信基金管理有限公司副督察长。

赵琳女士,副总经理,硕士学历。曾任华安基金管理有限公司基金注册部副总监;中银基金管理有限公司基金运营部总监;汇丰晋信基金管理有限公司基金运营部总监;现任汇丰晋信基金管理有限公司首席运营官。

张毅杰先生,副总经理,硕士学历。曾任招商基金管理有限公司华东业务发展经理、天同基金管理有限公司机构理财部负责人、汇丰晋信基金管理有限公司总经理助理、直销业务部总监。

古韵女士,督察长,硕士学历。曾任国泰君安证券股份有限公司法律事务总部副经理,国联安基金管理有限公司监察稽核部副总监、监察稽核部总监、董事会秘书和总经理助理。

4. 本基金基金经理

方磊女士,华东师范大学数理统计系学士,新加坡南洋理工大学数学系硕士。方磊女士曾任职于新加坡辉立证券公司任金融工程师, 在三年任职期间,其运用金融量化模型,为公司自营业务建立了多种投资套利模型以及各类标的指数的优化复制模型, 包括股指期货与指数现货间、各类金融期货间(包括股票期货等)的套利模型,同时运用量化分析为公司做市商业务建立了程序化自动做市交易模型,其在海外证券市场上的金融交易模型研究以及量化投资有丰富的实战经验。回国后, 其分别任职于易评咨询有限公司顾问统计,以及德隆友联战略投资管理有限公司数据分析师等。参与易评咨询有限公司的中国基金评估业务体系筹建,依靠扎实的量化分析基础, 负责公司对中国市场的基金绩效评估工作,并运用基金风险调整后收益、业绩持续性以及择时能力等量化指标在中国基金指数建立方面进行了大量的研究和量化分析工作;参与德隆友联战略投资管理有限公司对集团下属分支机构的风险管理,运用数学模型理论,建立包括信用风险评估、流动性风险管理、资产负债结构管理以及利率风险管理等量化风险管理。

方磊女士于2006年加入汇丰晋信基金管理有限公司,曾任公司风险管理部副总监,协助管理层运用量化分析理论对各类投资组合进行业绩和风险绩效评估,并使用流动性风险、跟踪误差和投资组合周转率等辅助风险控制指标对基金投资风险定期进行动态风险管理。方磊女士不仅在风险量化分析和研究方面有扎实的理论功底,而且在运用量化分析工具进行证券投资的长期实践中,也积累了丰富的实战经验。

5. 投资委员会成员的姓名和职务

王栋,总经理;曹庆,投资部总监兼汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金、汇丰晋信双核策略混合型证券投资基金和汇丰晋信新动力混合型证券投资基金基金经理;王品,投资部副总监兼汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金基金经理;郑宇尘,固定收益部总监。基金管理人也可以根据需要增加或更换相关人员。

6. 上述人员之间不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

名称:中国邮政储蓄银行股份有限公司(简称:中国邮政储蓄银行)

住所:北京市西城区金融大街3号

办公地址:北京市西城区金融大街3号A座

法定代表人:李国华

成立时间:2007年3月6日

组织形式:股份有限公司

注册资本:570亿元人民币

存续期间:持续经营

基金托管资格批文及文号:证监许可【2009】673号

联系人:王瑛

联系电话:010－68858126

## 三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

（1）直销机构

汇丰晋信基金管理有限公司投资理财中心

地址:上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼17楼

电话:021-20376868

传真:021-20376989

联系人:王晶晶

客户服务中心电话:021-20376888

公司网址:www.hsbcjt.cn

汇丰晋信基金电子交易平台

网址:https://etrading.hsbcjt.cn/

联系人:王晶晶

电话:021-20376957

（2）代销机构

1）汇丰晋信恒生A股行业龙头指数证券投资基金A类基金份额代销机构:

■中国邮政储蓄银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区金融大街3号

办公地址:北京市西城区金融大街3号A座

法定代表人:李国华

客户服务电话:95580

联系人:王硕

传真:(010)68858117

公司网址:www.psbc.com

■交通银行股份有限公司

注册地址:上海市浦东新区银城中路188号

办公地址:上海市浦东新区银城中路188号

法定代表人:牛锡明

电话:(021)58781234

传真:(021)58408842

联系人:曹榕

客服电话:95559

网址:www.bankcomm.com

■中国建设银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区金融大街25号

办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人:王洪章

客户服务电话:95533

网址:www.ccb.com

■中国工商银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人:姜建清

电话:010-66106912

传真:021-66107914

联系人:田耕

客户服务电话:95588

网址:www.icbc.com.cn

■中国农业银行股份有限公司

住所:北京市东城区建国门内大街69号

办公地址:北京市东城区建国门内大街69号

法定代表人:刘士余

客户服务电话:95599

网址:www.abchina.com

■招商银行股份有限公司

住所:深圳市福田区深南大道7088号

法定代表人:秦晓

电话:(0755)83195834,82090060

传真:(0755)83195049,82090817

联系人:刘薇

客户服务热线:95555

网址:www.cmbchina.com

■上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址:上海市浦东新区浦东南路500号

办公地址:上海市中山东一路12号

法定代表人:吉晓辉

电话:(021)61618888

传真:(021)63604199

联系人:汤嘉惠、虞合云

客户服务热线:95528

公司网站:www.spdb.com.cn

■宁波银行股份有限公司

注册地址:浙江省宁波市中山东路294号

法定代表人:陆华裕

客户服务电话:96528(上海地区962528)

网址:www.nbcb.com.cn

■温州银行股份有限公司

住所、办公地址:温州市车站大道196号

法定代表人:邢增福

联系人:林波

电话:(0577)88990082

传真:(0577)88995217

客服电话:(0577)96699

网址:www.wzbank.cn

■中国民生银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区复兴门内大街2号

办公地址:北京市西城区复兴门内大街2号

法定代表人:董文标

电话:010-58351666

传真:010-83914283

联系人:董云巍

客户服务热线:95568

公司网站:www.cmbc.com.cn

■渤海银行股份有限公司

注册地址:天津市河西区马场道201-205号

办公地址:天津市河西区马场道201-205号

法定代表人:刘宝凤

联络人:王宏

电话:022-58316666

传真:022-58316569

客服电话:400-888-8811

公司网址:www.cbhb.com.cn

■上海农村商业银行股份有限公司

注册地址:上海市浦东新区银城中路8号15-20楼、22-27楼

办公地址:上海市银城中路8号中融碧玉蓝天大厦15层

法定代表人:胡平西

联系人:吴海平

电话:021-38576666

传真:021-50105124

客服电话:021-962999

公司网址:http://www.srcb.com

■洛阳银行股份有限公司

注册地址:洛阳市洛南新区开元大道256号洛阳银行大厦

法定代表人:王建甫

客服电话:96699

网址:http://www.bankofluoyang.com.cn

■平安银行股份有限公司

注册地址:深圳市深南中路1099号平安银行大厦

法定代表人:孙建一

客户服务电话:95511-3

网址:http://bank.pingan.com/

■山西证券股份有限公司

注册地址:山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼

办公地址:山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼

法定代表人:侯巍

联系人:张治国

联系电话:0351-8686703

传真:0351-8686619

客服电话:400-666-1618

网址:www.i618.com.cn

■国泰君安证券股份有限公司

注册地址:上海市浦东新区商城路618号

办公地址:上海市浦东新区银城东路168号上海银行大厦29楼

法定代表人:万建华

联系人:芮敏祺

联系电话:021-38676161

传真:021-38670161

客服电话:400-8888-666

网址:www.gtja.com

■申万宏源证券有限公司

注册地址:上海市徐汇区长乐路989号45层

办公地址:上海市徐汇区长乐路989号45层

法定代表人:李梅

联系人:黄莹

电话:021-33389888

传真:021-33388224

客户服务电话:95523或4008895523

网址:www.swhysc.com

■中国银河证券股份有限公司

注册地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人:陈有安

联系人:田薇

电话:010-66568430

传真:(010)66568116

客服电话:400-8888-888

网址:www.chinastock.com.cn

■海通证券股份有限公司

注册地址:上海市淮海中路98号

办公地址:上海市广东路689号

法定代表人:王开国

联系人:金芸、李笑鸣

电话:021-23219000

传真:021-23219100

客服电话:95553或拨打各城市营业网点电话

网址:www.htsec.com

■华泰证券有限责任公司

注册地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

办公地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

法定代表人:吴万善

联系人:樊昊

电话:025-84457777

传真:025-84579763

客户服务电话:95597

网址:www.htsc.com.cn

■兴业证券股份有限公司

注册地址:福州市湖东路268号

办公地址:福州市湖东路268号

法定代表人:兰荣

联系人:杨盛芳

电话:0591-87613888

传真:0591-87546058

客户服务电话:400-8888-123

网址:www.xyzq.com.cn

■国信证券股份有限公司

注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26层

办公地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26层

法定代表人:何如

联系人:齐晓燕

电话:0755-82133066

传真:0755-82133302

客户服务电话:95536

网址:www.guosen.com.cn

■中信证券股份有限公司

注册地址:广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第A层

办公地址:北京市朝阳区新源南路6号京城大厦3层

法定代表人:王东明

联系人:陈忠

电话:010-84683893

传真:010-84865560

客服电话:010-85108888

网址:www.citic.com

■光大证券股份有限公司

注册地址:上海市静安区新闸路1508号

办公地址:上海市静安区新闸路1508号

法定代表人:徐浩明

联系人:刘晨、李芳芳

电话:021-22169999

传真:021-22169134

客户服务电话:95525、10108998

网址:www.ebscn.com

■中国国际金融股份有限公司

注册地址:北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

办公地址:北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

法定代表人:丁学东

联系人:杨涵宇 陈曦

客服电话:400 910 1166

公司网址:www.cicc.com.cn

■天相投资顾问有限公司

注册地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701

办公地址:北京市西城区新街口外大街28号C座5层

法定代表人:林义相

联系人:尹伶

电话:010-66045529

传真:010-660455 18

客服电话:010-66045678

天相投顾网址:www.txsec.com、www.txjijin.com

天相基金网网址:www.jjm.com.cn

■东方证券股份有限公司

注册地址:上海市中山北路318号2号楼21-29楼

办公地址:上海市中山北路318号2号楼21-29楼

法定代表人:潘鑫军

联络人:吴宇、沈燕

电话:021-63325888

传真:021-63326173

客服电话:95503

公司网址:www.dfzq.com.cn

■国金证券股份有限公司

注册地址:成都市东城根上街95号

办公地址:成都市东城根上街95号6、16、17楼

法定代表人:雷波

联系人:金喆

客户服务电话:400-660-0109

网址:www.gjzq.com.cn

■国元证券股份有限公司

注册地址:合肥市寿春路179 号

法定代表人:凤良志

联系人:李蔡

电话:0551-2207938

传真:0551-2207965

客服电话:4008-888-777、95578

公司网址:www.gyzq.com.cn

■中信证券(浙江)有限责任公司

注册地址: 浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层

办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层

法定代表人:沈强

联系人:丁思聪

客户服务电话:96598

网址:http://bigsun.qianyan.biz

■广发证券股份有限公司

注册地址:广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316房)

办公地址:广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼

法定代表人:孙树明

联系人:黄岚

统一客户服务热线:95575或致电各地营业网点

公司网站:www.gf.com.cn

■中信建投证券股份有限公司

注册地址:朝阳区安立路66号4号楼

办公地址:北京市东城区朝内大街188号

法定代表人:张佑君

联系人:权唐

电话:010-85130577

传真:010-65182261

客户服务电话:400-8888-108(免长途费)

网址:www.csc108.com

■安信证券股份有限公司

注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

法定代表人:牛冠兴

联系人:陈剑虹

电话:0755-82558305

传真:0755-82558355

客服电话:4008001001

公司网址:www.essences.com.cn

■中信证券(山东)有限责任公司

法定代表人:杨宝林

注册地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层

办公地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层

基金业务联系人:吴忠超

电话:0532-85022326

传真:0532-85022605

客户服务电话:95548

公司网址:www.citicssd.com

■招商证券股份有限公司

注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

法定代表人:宫少林

联系人:林生迎

电话:0755-82943666

传真:0755-82943636客服电话: 400-8888-111、95565

网址:www.newone.com.cn

■深圳众禄基金销售有限公司

注册地点: 深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元

法定代表人:薛峰

客户服务电话:4006-788-887

联系人:张玉静

网址:www.zlfund.cn及www.jjmmw.com

■上海天天基金销售有限公司

注册地点:上海浦东新区峨山路613号6幢551室

法定代表人:其实

联系人:朱钰

客户服务电话:400-1818-188

网址:www.1234567.com.cn

■杭州数米基金销售有限公司

注册地点:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼

法定代表人:陈柏青

联系人:周嫦旻

客户服务电话:4000766123

网址:www.fund123.cn

■浙江同花顺基金销售有限公司

注册地点:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903

法定代表人:李晓涛

联系人:杨翼

公司网站:www.10jqka.com.cn

客服电话:95105-885 0571-56768888

■上海好买基金销售有限公司

注册地点:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室

法定代表人:杨文斌

联系人:薛年

客户服务电话:400-700-9665

网址:ww.ehowbuy.com

■诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司

注册地点:上海市金山区廊下镇漕廊公路7650号205室

法定代表人:汪静波

联系人:姚思轶

公司网站:www.noah-fund.com

客服电话:400-821-5399

■东海证券有限责任公司

注册地点:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼

法定代表人:朱科敏

联系人:汪正

公司网站:www.longone.com.cn

客服电话:400-8888-588

■齐鲁证券有限责任公司

注册地点:山东省济南市经七路86号

法定代表人:李玮

公司网站:www.qlzq.com.cn

客服电话:95538

■浙商证券股份有限公司

注册地点:浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座

法定代表人:吴承根

联系人:许嘉行

公司网站:www.stocke.com.cn

客服电话:(浙江省内)967777

■华鑫证券有限责任公司

注册地点:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元

法定代表人:洪家新

联系人:陈敏

公司网站:www.cfsc.com.cn

客服电话:021-32109999;029-68918888

■信达证券股份有限公司

注册地点:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人:高冠江

联系人:唐静

公司网址:www.cindasc.com

客服电话:400-800-8899

■和讯信息科技有限公司

注册地点:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层

法定代表人:王莉

联系人:周轶

公司网站:licaike.hexun.com

客服电话:4009-200-022

■北京展恒基金销售有限公司

注册地点:北京市顺义区后沙峪镇安富街6号

法定代表人:闫振杰

联系人:焦琳

公司网站:www.myfund.com

客服电话:400-888-6661

■华安证券股份有限公司

注册地点:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号

法定代表人:李工

公司网站:www.hazq.com

客服电话:400-809-6518

■长江证券股份有限公司

注册地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦

办公地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人:杨泽柱

电话:021-68751929

联系人:李良

客户服务电话:95579

网址:www.95579.com

■东兴证券股份有限公司

注册地址:北京市西城区金融街5号新盛大厦B座12、15层

办公地址:北京市西城区金融街5号新盛大厦B座12、15层

法定代表人: 魏庆华

联系人: 汤漫川

电话: 010-66555316

传真: 010-66555147

客户服务电话:4008888993

网址:www.dxzq.net

2)汇丰晋信恒生A股行业龙头指数证券投资基金C类基金份额代销机构:

■交通银行股份有限公司

注册地址:上海市浦东新区银城中路188号

办公地址:上海市浦东新区银城中路188号

法定代表人:牛锡明

电话:(021)58781234

传真:(021)58408842

联系人:曹榕

客服电话:95559

网址:www.bankcomm.com

■渤海银行股份有限公司

注册地址:天津市河西区马场道201-205号

办公地址:天津市河西区马场道201-205号

法定代表人:刘宝凤

联络人:王宏

电话:022-58316666

传真:022-58316569

客服电话:400-888-8811

公司网址:www.cbhb.com.cn

■上海农村商业银行股份有限公司

注册地址:上海市浦东新区银城中路8号15-20楼、22-27楼

办公地址:上海市银城中路8号中融碧玉蓝天大厦15层

法定代表人:胡平西

联系人:吴海平

电话:021-38576666

传真:021-50105124

客服电话:021-962999

公司网址:http://www.srcb.com

■平安银行股份有限公司

注册地址:深圳市深南中路1099号平安银行大厦

法定代表人:孙建一

客户服务电话:95511-3

网址:http://bank.pingan.com/

（二）注册登记机构

名称:汇丰晋信基金管理有限公司

注册地址: 上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼17楼

法定代表人:杨小勇

联系人:赵琳

联系电话:021-20376892

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称:通力律师事务所

注册地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人:韩炯

电话:021-31358666

传真:021-31358600

联系人:黎明

经办律师:吕红 黎明

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所:上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼

执行事务合伙人/首席合伙人:杨绍信

联系电话:021-2323 8888

传真电话:021-2323 8800

经办注册会计师:薛竞、赵钰

联系人:赵钰

## 四、基金的名称

汇丰晋信恒生A股行业龙头指数证券投资基金

## 五、基金的类型

股票型证券投资基金

## 六、基金的投资目标

本基金主要采取完全复制方法进行指数化投资,通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度控制在0.35%以内,年化跟踪误差控制在4%以内,以实现对标的指数的有效跟踪。

## 七、基金的投资方向

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括标的指数的成份股与备选成份股、新股(一级市场初次发行或增发)、债券以及法律法规或中国证监会批准的允许本基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他金融产品出现后,本基金在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金投资于标的指数的成份股与备选成份股的组合比例不低于基金资产净值的90%, 现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。

## 八、基金的投资策略

本基金为被动式指数基金,采用完全复制指数的投资策略,按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整,力争实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度控制在0.35%以内,年化跟踪误差控制在4%的投资目标。

当成份股发生分红、配股、增发等公司事件时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪业绩比较基准的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或因其他原因导致无法有效复制和跟踪基准指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,最终使跟踪误差控制在限定的范围之内。

本基金建仓时间为3个月,3个月之后本基金投资组合比例达到《基金合同》的相关规定。

1、股票投资策略

本基金主要采取完全复制法来跟踪恒生A股行业龙头指数, 即按照恒生A股行业龙头指数成份股组成及权重构建股票指数化投资组合。为求基金实际投资组合尽量贴近标的指数的表现,减小跟踪误差,基金管理人将根据实际情况对基金投资组合进行适当调整:

（1）指数成份股定期或临时调整。基金管理人将预测指数成份股调整方案,并判断指数成份股调整对投资组合的影响,在此基础上确定组合调整策略。

（2）基金发生申购赎回、参与新股申购等影响跟踪效果的情形。基金管理人将分析这些情形对跟踪效果的影响,据此对投资组合进行相应调整。

（3）指数成份股出现股本变化、增发、配股、派发现金股息等公司事件时,基金管理人将密切关注这些情形对指数的影响,并据此确定相应的投资组合调整策略。

（4）当标的指数成份股因停牌、流动性不足等因素导致基金无法按照指数权重进行配置, 基金管理人将综合考虑跟踪误差和投资者利益,选择相关股票进行适当替代。本基金选择恒生A股行业龙头指数成份股或备选成份股构建替代成份股。

2、债券投资策略:

本基金可以投资于剩余期限在一年以内的政府债券和回购,其主要的作用为现金的替代资产,其投资的目的是在实现资产更高的流动性而非收益性。基金管理人将优先选择流动性较好的政府债券进行投资,并通过对基金现金需求的科学分析,合理分配基金资产在债券上的配置比例。

## 九、业绩比较基准

业绩比较基准 =恒生A股行业龙头指数*95%+银行活期存款收益率(税后)*5%

## 十、风险收益特征

本基金属于股票型指数基金,属证券投资基金中的高风险、高收益品种,其长期平均风险和收益预期高于混合型基金,债券型基金和货币市场基金。

## 十一、基金的投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证基金投资组合报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金的托管人——中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定,复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本基金投资组合报告的报告期为2015年4月1日起至6月30日。本报告中的财务资料未经审计。

11.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 62,743,181.57 | 91.12 |
| | 其中:股票 | 62,743,181.57 | 91.12 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 5,076,956.78 | 7.37 |
| 7 | 其他资产 | 1,040,545.33 | 1.51 |
| 8 | 合计 | 68,860,683.68 | 100.00 |

11.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 6,493,536.69 | 9.85 |
| C | 制造业 | 23,216,645.40 | 35.21 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 5,096,645.44 | 7.73 |
| E | 建筑业 | 4,918,591.92 | 7.46 |
| F | 批发和零售业 | 1,358,012.70 | 2.06 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 4,934,441.93 | 7.48 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 1,832,758.97 | 2.78 |
| J | 金融业 | 10,886,132.62 | 16.51 |
| K | 房地产业 | 2,624,504.52 | 3.98 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 928,199.80 | 1.41 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | 453,711.58 | 0.69 |
| | 合计 | 62,743,181.57 | 95.16 |

11.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 601988 | 中国银行 | 691,068 | 3,379,322.52 | 5.13 |
| 2 | 000651 | 格力电器 | 49,287 | 3,149,439.30 | 4.78 |
| 3 | 601989 | 中国重工 | 208,613 | 3,087,472.40 | 4.68 |
| 4 | 601398 | 工商银行 | 530,337 | 2,800,179.36 | 4.25 |
| 5 | 000002 | 万 科A | 180,751 | 2,624,504.52 | 3.98 |
| 6 | 600519 | 贵州茅台 | 9,918 | 2,555,372.70 | 3.88 |
| 7 | 601668 | 中国建筑 | 295,110 | 2,452,364.10 | 3.72 |
| 8 | 600028 | 中国石化 | 313,328 | 2,212,095.68 | 3.35 |
| 9 | 601288 | 农业银行 | 578,560 | 2,146,457.60 | 3.26 |
| 10 | 601006 | 大秦铁路 | 129,992 | 1,825,087.68 | 2.77 |

11.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

11.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

11.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

11.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

11.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

11.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

11. 9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

11. 9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

11.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

11.10.1 本基金投资国债期货的投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

11.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

11.10.3 本基金投资国债期货的投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

11.11 投资组合报告附注

11.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

11.11.2 本基金投资的前十名股票中, 没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

11.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 157,506.31 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,165.45 |
| 5 | 应收申购款 | 881,873.57 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,040,545.33 |

11.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

11.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

11.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,投资组合报告中,市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## 十二、基金的业绩

本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

（一）基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

1. 汇丰晋信恒生龙头指数A

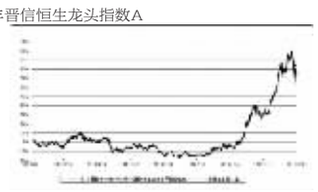
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2012/8/1(基金合同生效日)-2012/12/31 | 4.28% | 0.94% | 5.62% | 0.97% | -1.34% | -0.03% |
| 2013/1/1-2013/12/31 | -13.09% | 1.08% | -14.37% | 1.06% | 1.28% | 0.02% |
| 2014/1/1-2014/12/31 | 48.18% | 1.08% | 47.39% | 1.10% | 0.79% | -0.02% |
| 2015/1/1-2015/6/30 | 28.56% | 2.27% | 32.15% | 2.23% | -3.59% | 0.04% |

2.汇丰晋信恒生龙头指数C

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2015/4/1-2015/6/30 | 15.86% | 2.57% | 17.72% | 2.48% | -1.86% | 0.09% |

（二）基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

1. 汇丰晋信恒生龙头指数A



注:

1.按照基金合同的约定,本基金的投资组合比例为:投资于标的指数的成份股与备选成份股